

私募基金信息披露年度报表

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	瑞达期货-瑞智无忧晨鑫集合资产管理计划
基金编码	SNR904
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2021-01-29
基金管理人	瑞达期货股份有限公司
基金托管人（如有）	兴业证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	3,124.120506
基金到期日期	2031-01-28

1.2 基金产品说明

投资目标	在风险适度可控前提下，追求稳定、长期的适度收益。
投资策略	本产品致力于通过覆盖多市场的多元化投资品种以及投资策略的多样性和灵活性，根据市场运行状态，采用多品种、多周期、多策略管理客户资产，通过调整投资品种结构比例，设置合理的风险控制级别，通过人工为主、结合系统信号的方式积极主动参与市场交易，实现以较少的投资风险来获取较多投资收益。
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本计划为R4（中高）等级产品，适合风险识别、评估、承受能力为C4（积极）、C5（激进）的合格投资者（本产品不接受风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者认购）

1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		瑞达期货股份有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	林毅娜	李少峰
	联系电话	0592-3273105	021-20370710
	电子邮箱	rdqhzg2@163.com	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
传真		0592-3273105	0591-38507797
注册地址		福建省厦门市思明区桃园路18号26-29层	福州市湖东路268号证券大厦
办公地址		福建省厦门市思明区桃园路18号26-29层	福州市湖东路268号证券大厦
邮政编码		361000	350003

法定代表人

林志斌

杨华辉

1.4 信息披露方式

-

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	厦门市湖里区环岛干道万科云玺2号楼B座7-9楼
注册登记机构	兴业证券股份有限公司	上海市浦东新区长柳路36号
外包机构	兴业证券股份有限公司	上海市浦东新区长柳路36号

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	-234,755.31	0	0
本期利润	1,062,648.94	0	0
期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	-3,813,033.81	0	0
期末可供分配基金份额利润	-0.1221	0	0
期末基金净资产	28,354,526.81	0	0
报告期期末单位净值	0.9076	0	0
累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	3.18%	0.00%	0.00%

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率 标准差(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准收 益率标准率(%)
当年	3.18	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效 起至今	3.18	0.00	0.00	0.00

备注：

-

注：

净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值。

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，一般保留至小数点后2位。

2.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额分 红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2021	0.1242	1,023,588.80	2,540,979.24	3,564,568.04	-
2020	0	0	0	0	-
2019	0	0	0	0	-

备注：

-

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	2,400.086667
报告期期间基金总申购份额	1,524.033839
减：报告期期间基金总赎回份额	800.000000
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	3,124.120506

备注：

-

如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

4、管理人说明的其他情况

4.1 基金经理简介

本产品基金经理为张夕阳。

张夕阳，博士研究生，2010年加盟瑞达期货，先后从事商品及金融衍生品研究，负责资管管理产品策略开发、投资、结构化产品设计等。具有多年的从业经验和丰富的专业金融投资经历与产品管理经验，累计管理资金CTA总规模60亿以上。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责

的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合（策略）享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象（策略）备选库，制定明确的（策略）备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易执行方面，本管理人实行了集中交易制度和公平的交易分配制度。投资策略是通过资管示范账户进行程序化自动交易，并向交易员提示交易合约及交易方向，交易员根据示范账户的交易提示，通过策略子账户进行批量交易，即采用相同策略的不同资管产品，交易员下单交易指令后，金牛资管系统依据事先设定的交易参数，自动分配到不同资管产品的期货账户进行交易。资管示范账户进行定期轮换。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《瑞达期货资产管理业务交易监控制度》，明确定义了在投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。重点监控是否存在以下情形：（一）通过自成交影响合约价格；（二）成交价格明显超出合理范围。

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金主要投资于以商品期货、金融期货等为代表的商品及金融衍生品相关资产。无特殊合同约定，本基金采取“多品种、多周期、多策略”组合模式，以相对均衡的配置分散投资风险，增加了基金资产抵抗风险的能力；同时，采用资金管理优势提升资产收益，达到“风险分散、盈利集中”的效果。

尽管国内经济下行压力加大，地产市场延续收紧态势，但在全球流动性宽松、供需错配、碳中和行动、极端天气等因素的驱动下，2021年大宗商品市场延续牛市行情，绝大多数商品价格持续攀升。伴随着监管政策出手降温，强势品种在经历了五月和十月的大幅拉升后迎来大幅反转，全年商品市场波动剧烈，南华商品指数波动率创下12年来新高，工业品、能化、金属指数波动率均超过20%，相较而言农产品表现得较为平稳。

三四月份黑色系及有色金属板块一路上行，特别是铁矿石为代表的黑色系板块大幅走高。国常会三提大宗商品价格，发改委、交易所接连出手维护大宗商品价格稳定，通过一系列措施为市场降温。伴随着监管连续出手，叠加前期涨幅过快以及供需紧张的预期减弱，商品期货价格高位回落，市场整体计入到相对无序的行情波动中。这也令CTA策略下半年的表现整体低于预期。

六至九月黑色系品种轮番上涨，而中秋国庆假期前，各地运动式减排、限电限产以及海外能源危机的影响愈演愈烈，硅铁、动力煤、锰硅以及高度相关的能化板块呈现指数级式的上涨。随着管理层及时采取保供稳价措施以及对运动式减排的纠偏，市场行情再度出现不同程度的反弹。期间农产品行情相对独立，全年保持平稳上行，反观在疫情不确定性减弱与全球货币政策趋紧预期不断强化的影响下，贵金属板块整体呈现回落的走势。

相比于商品市场的跌宕起伏，A股市场则是暗潮涌动，指数整体保持平稳，板块轮动则异常激烈，而这也催生了股指期货品种间套利的机会。价值股地产、白酒、医药生物、教育持续萎靡，令沪深300与上证50指数表现疲软。与此同时，电动车、光伏、新能源、周期行业轮番崛起，驱动中证500指数强势领跑市场。在极度分化的市场行情下，IF-IH-IC间的套利机会再度显现。

2022年开年俄乌局势恶化，令商品与金融市场呈现截然相反的走势。在能源价格持续飙升的带动下，商品价格再度迎来快速上行的走势，反观地缘政治风险令全球股市避险情绪显著升温，股指期货持续下探。不过随着战事的不断推进，地缘风险的影响预计将趋于弱化，同时随着全球疫情防控趋于松绑，商品供需矛盾有望得到一定的缓解。上半年通胀继续升温、国内刺激经济措施加码，地缘关系不确定性依然较大，但在连续快速上扬后，随着美联储首次加息落地，全球资产全球资产配置可能将进入调整期。下半年全球加息频率与次数增多，俄乌局势的影响预计也将与历次战争类似，对市场的影响日趋减弱，商品市场的整体表现或将弱于上半年，反观在经历连续调整后，股指期货有望重整旗鼓，显著分化商品与A股走势预计将逐渐回归。

报告期内，南华商品指数上涨20.94%，沪深300指数下跌5.2%。关于本基金的运作

，CTA仓位保 证金占比维持在19%-27%的水平，因净值不同和根据市场波动情况，仓位存在差异。
未来，本基金研发团队将密切关注市场变化趋势，谨慎勤勉、恪尽职守，在保护投资者利益的前提下力争实现对收益增长。

5 、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本次报告期内，基金托管人兴业证券股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定和基金合同的约定，勤勉尽责履行基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本次报告期内，基金托管人根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基金托管人复核了管理人编制的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

6 、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2021-12-31	2020-12-31
资产：	0	0
银行存款	0.03	0
结算备付金	15,264,916.69	0
存出保证金	13,216,359.00	0
交易性金融资产	0	0
其中：股票投资	0	0
基金投资	0	0
债券投资	0	0
资产支持证券投资	0	0
贵金属投资	0	0
衍生金融资产	0	0
买入返售金融资产	0	0
应收证券清算款	0	0
应收利息	0	0
应收股利	0	0
应收申购款	0	0
递延所得税资产	0	0
其他资产	0	0
资产总计	28,481,275.72	0
负债和所有者权益	2021-12-31	2020-12-31
负债：	0	0
短期借款	0	0

交易性金融负债	0	0
衍生金融负债	0	0
卖出回购金融资产款	0	0
应付证券清算款	0	0
应付赎回款	0	0
应付管理人报酬	116,825.66	0
应付托管费	1,557.68	0
应付销售服务费	0	0
应付交易费用	0	0
应交税费	6,029.08	0
应付利息	0	0
应付利润	0	0
递延所得税负债	0	0
其他负债	2,336.49	0
负债合计	126,748.91	0
所有者权益：	0	0
实收基金	31,241,205.06	0
未分配利润	-2,886,678.25	0
所有者权益合计	28,354,526.81	0
负债和所有者权益总计	28,481,275.72	0

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2021-01-29 至 2021-12-31	- 至 2020-12-31
一、收入	3,798,950.01	0
1、利息收入	7,450.69	0
其中：存款利息收入	7,450.69	0
债券利息收入	0	0
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售金融资产收入	0	0
其他利息收入	0	0
2、投资收益（损失以“-”填列）	2,501,496.67	0
其中：股票投资收益	0	0
基金投资收益	0	0
债券投资收益	0	0
资产支持证券投资收益	0	0
贵金属投资收益	0	0
衍生工具收益	2,501,496.67	0
股利收益	0	0

3、公允价值变动收益		
(损失以“-”填列)	1,298,050.22	0
4、汇兑收益(损失以“-”填列)	0	0
5、其他收入(损失以“-”填列)	-8,047.57	0
减：二、费用	2,736,301.07	0
1. 管理人报酬	450,553.85	0
其中：固定管理费	450,553.85	0
业绩报酬	0	0
2、托管费	6,007.49	0
3、销售服务费	0	0
4、外包服务费	9,010.97	0
5、交易费用	2,269,117.08	0
6、利息支出	0	0
其中：卖出回购金融资产支出	0	0
7、其他费用	1,611.68	0
三、利润总额		
(亏损总额以“-”号填列)	1,062,648.94	0
减：所得税费用	0	0
四、净利润		
(净亏损以“-”号填列)	1,062,648.94	0

备注：

-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期		
	2021-01-29	至	2021-12-31
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	24,000,866.67	0	24,000,866.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0	1,062,648.94	1,062,648.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	7,240,338.39	-384,759.15	6,855,579.24
其中：1、基金申购			

款	15,240,338.39	500,640.85	15,740,979.24
2、基金赎回款	-8,000,000.00	-885,400.00	-8,885,400.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0	-3,564,568.04	-3,564,568.04
五、期末所有者权益（基金净值）	31,241,205.06	-2,886,678.25	28,354,526.81
项目	上年度可比期间		
	-	至	2020-12-31
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	0	0	0
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0	0	0
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	0	0	0
其中：1、基金申购款	0	0	0
2、基金赎回款	0	0	0
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0	0	0
五、期末所有者权益（基金净值）	0	0	0

备注：

-

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	0.03
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
	结算备付金	15,264,916.69
	存出保证金	13,216,359
	股票投资	-

境内证券投资规模	债券投资	
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	
	其中：信用债	
	资产支持证券	
	基金投资（公募基金）	
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	13,216,359
	买入返售金融资产	
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
	私募基金产品投资	
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	
基金负债情况	债券回购总额	
	融资、融券总额	
	其中：融券总额	
	银行借款总额	
	其他融资总额	

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0	0
B	采矿业	0	0
C	制造业	0	0
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E	建筑业	0	0
F	批发和零售业	0	0

G	交通运输、仓储和邮政业	0	0
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0	0
J	金融业	0	0
K	房地产业	0	0
L	租赁和商务服务业	0	0
M	科学研究和技术服务业	0	0
N	水利、环境和公共设施管理业	0	0
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0
P	教育	0	0
Q	卫生和社会工作	0	0
R	文化、体育和娱乐业	0	0
S	综合	0	0
	合计	0	0

备注：

—

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
港股通	0.00	0.00
合计	—	—

备注：

—

信息披露报告是否经托管机构复核：

是

